

Ossiam Euro Government Bonds 3-5Y Carbon Reduction UCITS ETF 1C (EUR)

INVESTMENTSTRATEGIE

Das Anlageziel des Ossiam Euro Government Bonds 3-5Y Carbon Reduction Fonds ist, vor Gebühren die Wertentwicklung des ICE 3-5 Year Euro Government Carbon Reduction Index nachzubilden.

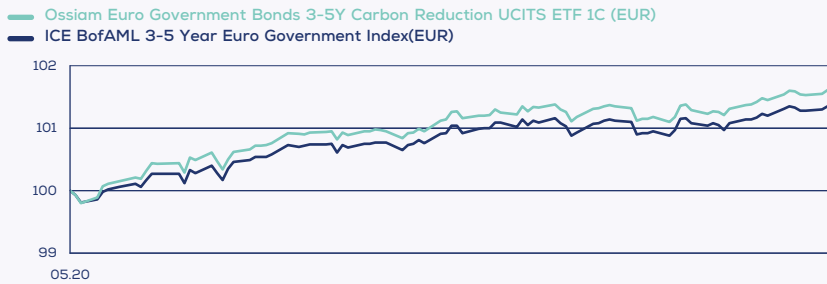
Der Index setzt sich aus einer Auswahl von auf EUR lautenden Staatsanleihen mit einer Restlaufzeit von mehr als 3 Jahren und weniger als 5 Jahren zusammen, die von Mitgliedern der Eurozone ausgegeben werden.

Die Strategie zielt auf eine signifikante Reduzierung der durchschnittlichen Kohlenstoffmetrik des ICE BofAML 3-5 Year Euro Government Index (das Anlageuniversum) durch ein Optimierungsverfahren, das die Abweichung der Gewichte der Anleihen im Index im Verhältnis zu den Anleihengewichten im Anlageuniversum minimiert. Die Kohlenstoffmetrik der Strategie wird unter Verwendung der Kohlenstoffdaten jedes Landes, aus dem das Portfolio besteht, und ihrer jeweiligen Gewichte im Portfolio berechnet. Die Kohlenstoffmetrik ist die Kohlenstoffemission pro Kopf, ausgedrückt als t/CO₂/Kopf/Jahr für jedes Land.

Die Strategie:

1. Bietet ein Engagement in Kernanleihen der Eurozone mit einer Laufzeit von 3 bis 5 Jahren.
2. Reduziert langfristig den Kohlenstoff-Fußabdruck des Portfolios im Vergleich zum Kohlenstoff-Fußabdruck des Anlageuniversums.
3. Wendet ein Verfahren zur Optimierung der Anleihenallokation an, das die Abweichung von den Gewichten der Anleihen des Portfolios im Vergleich zum Anlageuniversum minimiert.

PRODUKT-(NETTO-)PERFORMANCE SEIT AUFLAGE DES FONDS



Von Ossiam berechnete Daten zum 30.09.2020. Quelle: Ossiam, ICE Data Indices LLC

(NETTO-)PERFORMANCE

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre annualisiert %	5 Jahre annualisiert %	Seit Auflage annualisiert %
Fonds	0,43	-	-	-	-	4,05
Index	0,45	-	-	-	-	4,35
Investment Universum	0,47	-	-	-	-	3,56

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.09.2020. Quelle: Ossiam, ICE Data Indices LLC

RISIKOKENNZAHLEN SEIT AUFLAGE DES FONDS

	Volatilität annualisiert %	Alpha % annualisiert	BETA	1-Jahr Tracking Error %	Sharpe Ratio	höchster Wertverlust %
Fonds	1,28	0,42	1,02	-	3,53	-0,28
Index	1,27	0,76	1,00	-	3,80	-0,26
Investment Universum	1,23	-	-	-	3,28	-0,28

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.09.2020. Quelle: Ossiam, ICE Data Indices LLC

WICHTIGE INFORMATIONEN: Die Angaben zur Wertentwicklung verstehen sich abzüglich der Gebühren. Der Wert einer Investition und die daraus resultierenden Einnahmen können variieren und der anfängliche Investitionsbetrag kann nicht garantiert werden. ETFs werden wie Aktien an den Börsen gehandelt und die Handelspreise können vom Nettoinventarwert des ETFs abweichen. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein zuverlässiger Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Risikohinweise: Es ist zu beachten, dass der Fonds neben dem allgemeinen Marktrisiko verschiedenen Risiken ausgesetzt ist. Hierzu gehören unter anderem Risiken aus dem Index, dem Einsatz von Derivaten, dem Gegenparteierrisiko und dem Risiko von geographisch konzentrierteren Investitionen. Um mehr über die Risiken zu erfahren, lesen Sie bitte die Wesentlichen Anlegerinformation (KIID) und den Verkaufsprospekt vor einer Investition.

Bitte beachten Sie, dass im Fall eines Währungsunterschiedes zwischen der Währung des Fonds-/der Anlageklasse und Ihrer Heimatwährung, Gewinne oder Verluste des Fonds/der Anlageklasse durch Wechselkursschwankungen (sowohl nach oben als auch unten) beeinflusst werden können.

SYNTHETISCHER RISIKO- UND ERTRAGSINDIKATOR (SRRI)

GERINGERES RISIKO HÖHERES RISIKO



IN DER REGEL NIEDRIGERE ERTRÄGE

IN DER REGEL HÖHERE ERTRÄGE

Der SRRI steht für das Risiko- und Renditeprofil, wie auch in der Wesentlichen Anlegerinformation dargestellt wird. Die niedrigste Kategorie kann nicht mit einer risikofreien Anlage gleichgesetzt werden. Der SRRI kann im Laufe der Zeit Veränderungen unterliegen und stellt keine Garantie dar.

INDEXDATEN

Name	ICE 3-5 Year Euro Government Carbon Reduction Index (EUR)
Investment Universum	ICE BofAML 3-5 Year Euro Government Index (EUR)
Bloomberg Ticker	E2CR Index
Auflagedatum	07.02.2020
Anlageklasse	Fixed Income
Häufigkeit der Neugewichtung	Monatlich

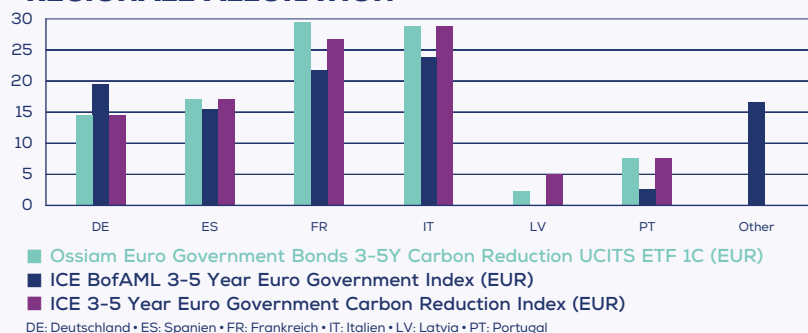
FONDSDATEN

Depotbank	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Rechtsform	Teilfonds des Ossiam Lux SICAV
UCITS	Ja
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Anlagevolumen des Fonds	EUR 236.494.958
Anlagevolumen der Anteilklasse	EUR 236.494.958
Nettoinventarwert	EUR 206.604
Anzahl der Anteile	1.144.680
Fondswährung	EUR
Währung der Anteilklasse	EUR
ISIN	LU2069380306
Auflagedatum	13.05.2020
Replikationsmethode	Physisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Total Expense Ratio	0,17%

HANDELSINFORMATION

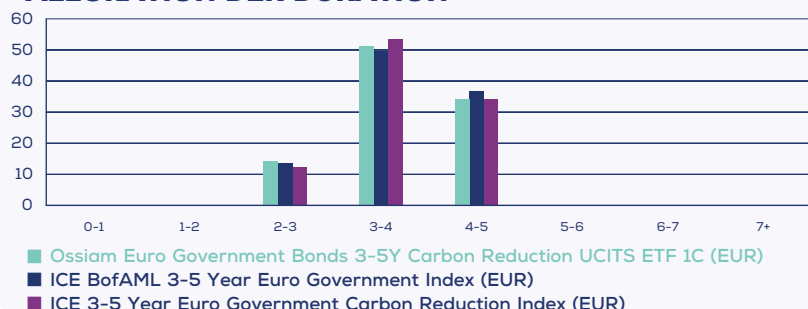
Annahmeschluss	15:00 Uhr (Luxemburger Zeit)
Mindestanlagesumme (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine Börse)	1 Anteil
Zeichnung auf dem Primärmarkt nur autorisierten Teilnehmern und zugelassenen Investoren vorbehalten	
XETRA in EUR	OG35 GY Equity
SIX Swiss Exchange in EUR	OG35 SW Equity
Borsa Italiana in EUR	OG35 IM Equity

REGIONALE ALLOKATION



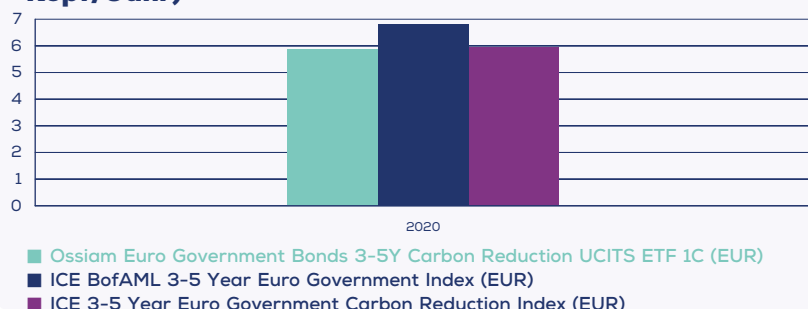
Von Ossiam berechnete Daten zum 30.09.2020. Quelle: Ossiam, Bloomberg, Standard & Poor's

ALLOKATION DER DURATION



Von Ossiam berechnete Daten zum 30.09.2020. Quelle: Ossiam, ICE Data Indices LLC

TREIBHAUSGASEMISSIONEN pro Kopf (in CO2-Tonnen/Kopf/Jahr)**



Von Ossiam berechnete Daten zum 30.09.2020. Quelle: Ossiam, ICE Data Indices LLC

**Durchschnittliche Treibhausgasemissionen von dem Pro-Kopf-Verbrauch fossiler Brennstoffe.

TOP 10 POSITIONEN (%)

	Ossiam Euro Government Bonds 3-5Y Carbon Reduction	ICE BofAML 3-5 Year Euro Government Index	ICE 3-5 Year Euro Government Carbon Reduction Index
FRTR 2 1/4 05/25/24	6,87	3,22	4,15
FRTR 4 1/4 10/25/23	4,84	4,45	4,84
FRTR 0 03/25/25	4,67	3,81	4,68
FRTR 1 3/4 11/25/24	4,49	3,57	4,49
FRTR 0 1/2 05/25/25	4,34	3,35	4,34
FRTR 0 03/25/24	4,26	3,38	4,27
PGB 5.65 02/15/24	4,22	1,31	4,23
BTPS 1 3/4 07/01/24	3,61	1,53	1,84
PGB 4.95 10/25/23	3,31	1,25	3,32
BTPS 5 03/01/25	2,80	2,50	2,80

PORTFOLIOMERKMALE

	ICE 3-5 Year Euro Government Carbon Reduction Index	ICE BofAML 3-5 Year Euro Government Index
Duration (in years)	3,75	3,77
Adjusted Duration (in years)	3,77	3,79
Yield to Maturity %	-0,35	-0,42

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.09.2020. Quelle: Ossiam, ICE Data Indices LLC

KONTAKT / INFO

www.ossiam.com
 mail : info@ossiam.com
 TEL +33 1 84 79 42 70
 80 av. de la Grande Armée
 75017 PARIS - FRANCE

Dieses Dokument hat einen wirtschaftlichen und keinen regulatorischen Hintergrund.

Ossiam Lux (der SICAV) ist als Investmentgesellschaft mit variablem Kapital nach dem Gesetz des Großherzogtums Luxemburg eingetragen und wurde von der Luxemburger Marktaufsicht CSSF. Damit ist Ossiam verantwortlich für das Investment-Management, die Verwaltung und den Vertrieb der SICAV. Die Verwaltungsgesellschaft hat State Street Bank International GmbH, Luxemburg Branch, zur Verwaltungsstelle, Zahlstelle, Domizilierungsstelle sowie zum Vertreter der Gesellschaft, Registerführer und zur Transferstelle der SICAV ernannt. Ossiam, eine Tochtergesellschaft von Natixis Investment Managers (ehemals Natixis Global Asset Management), ist eine französische Kapitalanlagegesellschaft, die von der Autorité des Marchés Financiers (Zulassungnr. GP-10000016) zugelassen ist. Für die Vermarktung in Deutschland zugelassen.

Für Anleger in der Schweiz: Der Vertreter und die Zahlstelle des Fonds in der Schweiz ist RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Zürich Branch, Bleicherweg 7, 8027 Zürich.

„Das Finanzinstrument wird von der Solactive AG weder gesponsert noch beworben, verkauft oder auf sonstige Weise gefördert, und die Solactive AG gibt zu keiner Zeit eine ausdrückliche oder stillschweigende Garantie oder Zusicherung im Hinblick auf die Ergebnisse einer Nutzung des Index und/oder der Indexmarke oder des Indexpreises oder in anderer Hinsicht. Der Index wird von der Solactive AG berechnet und veröffentlicht. Die Solactive AG bemüht sich, sicherzustellen, dass der Index richtig berechnet wird. Unabhängig von ihren Verpflichtungen gegenüber dem Emittenten ist die Solactive AG nicht verpflichtet, Fehler im Index gegenüber Dritten anzuzeigen, insbesondere gegenüber Anlegern und/oder Finanzmittlern des Finanzinstruments. Weder die Veröffentlichung des Index durch die Solactive AG noch die Lizenzierung des Index oder der Indexmarke zur Nutzung in Verbindung mit dem Finanzinstrument stellen eine Empfehlung durch die Solactive AG zur Investition von Kapital in das entsprechende Finanzinstrument dar und sie stellen auch in keiner Weise eine Zusicherung oder Meinung der Solactive AG im Hinblick auf eine Investition in dieses Finanzinstrument dar.“

„Der Fonds wird von Moody's Analytics weder gesponsert noch beworben, verkauft oder auf sonstige Weise gefördert und Moody's Analytics gibt zu keiner Zeit eine vertragliche oder gesetzliche Garantie oder Zusicherung im Hinblick auf die Ergebnisse einer Nutzung des Index und/oder der Marke oder der Daten von Moody's Analytics oder in anderer Hinsicht ab. Bestimmte quantitative Finanzdaten, welche die Solactive AG bei der Berechnung und Veröffentlichung des Index verwendet, werden von Moody's Analytics zur Verfügung gestellt. Unbeschadet ihrer Verpflichtungen gegenüber dem Emittenten und der Solactive AG ist Moody's Analytics nicht verpflichtet, Fehler im Index gegenüber Dritten, wie unter anderem Anlegern und/oder Finanzmittlern des Fonds, anzuzeigen. Weder die Veröffentlichung des Index durch die Solactive AG noch die Lizenzierung der Daten oder des Warenzeichens von Moody's Analytics zur Nutzung in Verbindung mit dem Index und dem Fonds stellen eine Empfehlung durch Moody's Analytics zur Investition von Kapital in den Fonds dar, und sie stellen auch in keiner Weise eine Zusicherung oder Meinung von Moody's Analytics im Hinblick auf eine Investition in dieses Finanzinstrument dar.“

Dieses Dokument wurde zu Informationszwecken ausschließlich Finanzdienstleistern oder anderen professionellen Kunden oder qualifizierten Investoren und, soweit aufgrund lokaler Bestimmungen erforderlich, nur auf deren schriftlicher Anfrage zur Verfügung gestellt. Dieses Material ist nicht für Privatanleger bestimmt. Es liegt in der Verantwortung eines jeden Finanzdienstleisters sicherzustellen, dass das Angebot oder der Verkauf von Fondsanteilen oder Wertpapierdienstleistungen Dritter an seine Kunden im Einklang mit den jeweiligen nationalen Gesetzen steht.

In Deutschland und Österreich: Dieses Dokument wird von Natixis Investment Managers S.A. oder ihrer Zweigniederlassung Natixis Investment Managers S.A., Zweigniederlassung Deutschland, bereitgestellt. Natixis Investment Managers S.A. ist eine Luxemburger Verwaltungsgesellschaft, die von der Commission de Surveillance du Secteur Financier zugelassen wurde und die nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg gegründet wurde und unter Registernummer B 115843 registriert ist. Eingetragener Sitz von Natixis Investment Managers S.A. ist 2 rue Jean Monnet, L-2180 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg. Eingetragener Sitz von Natixis Investment Managers S.A., Zweigniederlassung Deutschland (Handelsregisternummer: HRB 88541) ist: Im Trutz Frankfurt 55, Westend Carrée, 7. Etage, Frankfurt am Main 60322, Deutschland.

In der Schweiz: Dieses Dokument wird von Natixis Investment Managers, Switzerland Sàrl, Rue du Vieux Collège 10, 1204 Genf, Schweiz, oder dessen Repräsentanz in Zürich, Schweizergasse 6, 8001 Zürich, ausschliesslich zu Informationszwecken herausgegeben.

Die oben erwähnte Gesellschaft ist eine Geschäftsentwicklungseinheit von Natixis Investment Managers, einer Holdinggesellschaft mit einem breit gefächerten Angebot spezialisierter Vermögensverwaltungseinheiten und Distributionsgesellschaften weltweit. Die Vermögensverwaltungstochtergesellschaften der Natixis Investment Managers führen regulierte Tätigkeiten nur in und von Jurisdiktionen aus/durch, in denen sie hierzu lizenziert oder autorisiert sind. Ihre Dienstleistungen und die Produkte, die sie verwalten, sind nicht allen Investoren in allen Jurisdiktionen zugänglich.

Obwohl Natixis Investment Managers die in diesem Dokument bereitgestellten Informationen, einschließlich der Informationen aus Drittquellen, für vertrauenswürdig hält, kann die Richtigkeit, Angemessenheit oder Vollständigkeit dieser Informationen nicht garantiert werden.

Die Bereitstellung dieses Dokuments und/oder Bezugnahmen auf bestimmte Wertpapiere, Sektoren oder Märkte in diesem Dokument stellen keine Anlageberatung oder eine Anlageempfehlung oder ein Angebot, Wertpapiere zu erwerben oder zu veräußern, oder ein Angebot von Dienstleistungen dar. Investoren sollten Anlageziele, Risiken und Kosten einer jeden Investition zuvor sorgfältig prüfen. Die Analysen, Meinungen und bestimmte Anlagethemen und Verfahren, auf die in diesem Dokument verwiesen wird, geben die Ansichten des Portfoliomanagers zum angegebenen Datum wieder. Sowohl diese als auch die dargestellten Portfoliobestände und Portfolioeigenschaften unterliegen einer stetigen Veränderung. Es kann keine Zusicherung gegeben werden, dass Entwicklungen in der Form eintreten, wie sie in diesem Dokument gegebenenfalls prognostiziert wurden. Dieses Dokument darf nicht, auch nicht teilweise, verbreitet, veröffentlicht oder reproduziert werden.

Alle Beträge in diesem Dokument sind in USD ausgewiesen, sofern nichts anderes angegeben ist.